



研究発表レポート④

~ Relative Strength Index (RSI) ~

West Village Investment 株式会社
岩本祐介







研究発表


MULTICHARTS DATA

研究発表のurlは以下のとおりです。


<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/study/>

※インジケータやストラテジーの挿入方法等の基本的な使い方、および、最適化の方法等は、第1回のボリンジャーバンド前編、後編をご覧ください。

第3回 移動平均線とその応用 動画  (資料 )

第2回 コロナショックによる暴落に関して - システムトレード的な見地から考察 - 

第1回 ボリンジャーバンド 前編  (資料 ) | 後編  (資料 )

試用版 マルチチャート 試用版 >> お申込みはこちら 



マルチチャートでのRSI

■RSI (Relative Strength Index)

パワーランゲージの記述方法 : **RSI(価格, 期間)**
価格は、**Open, High, Low, Close**から選択

※RSIの計算式

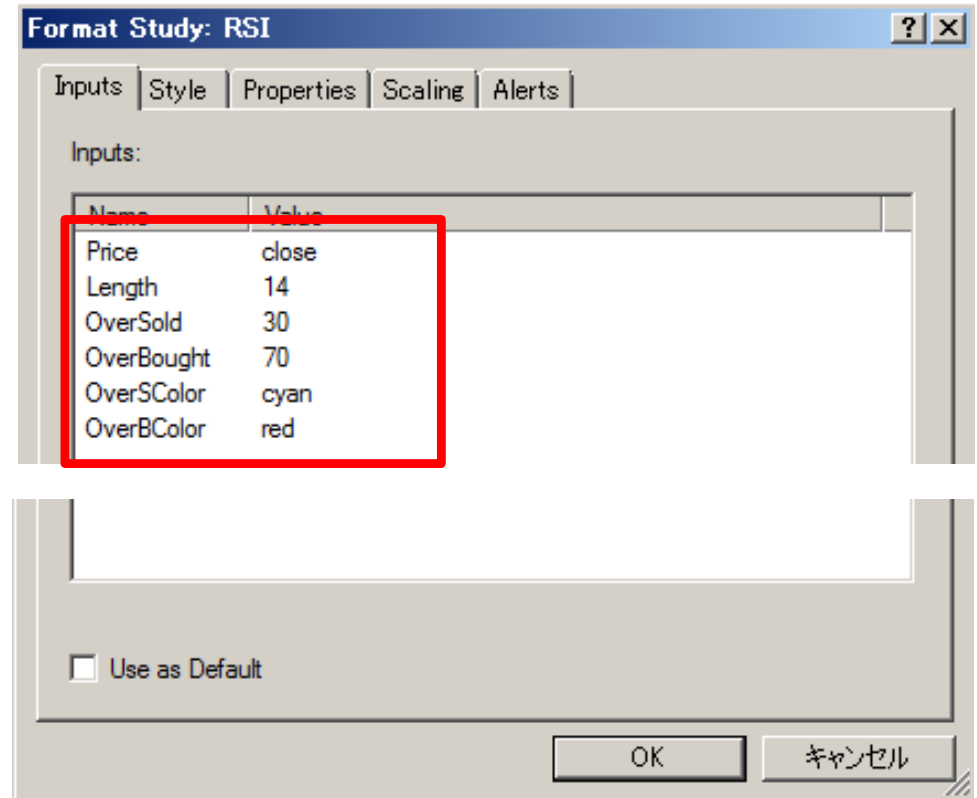
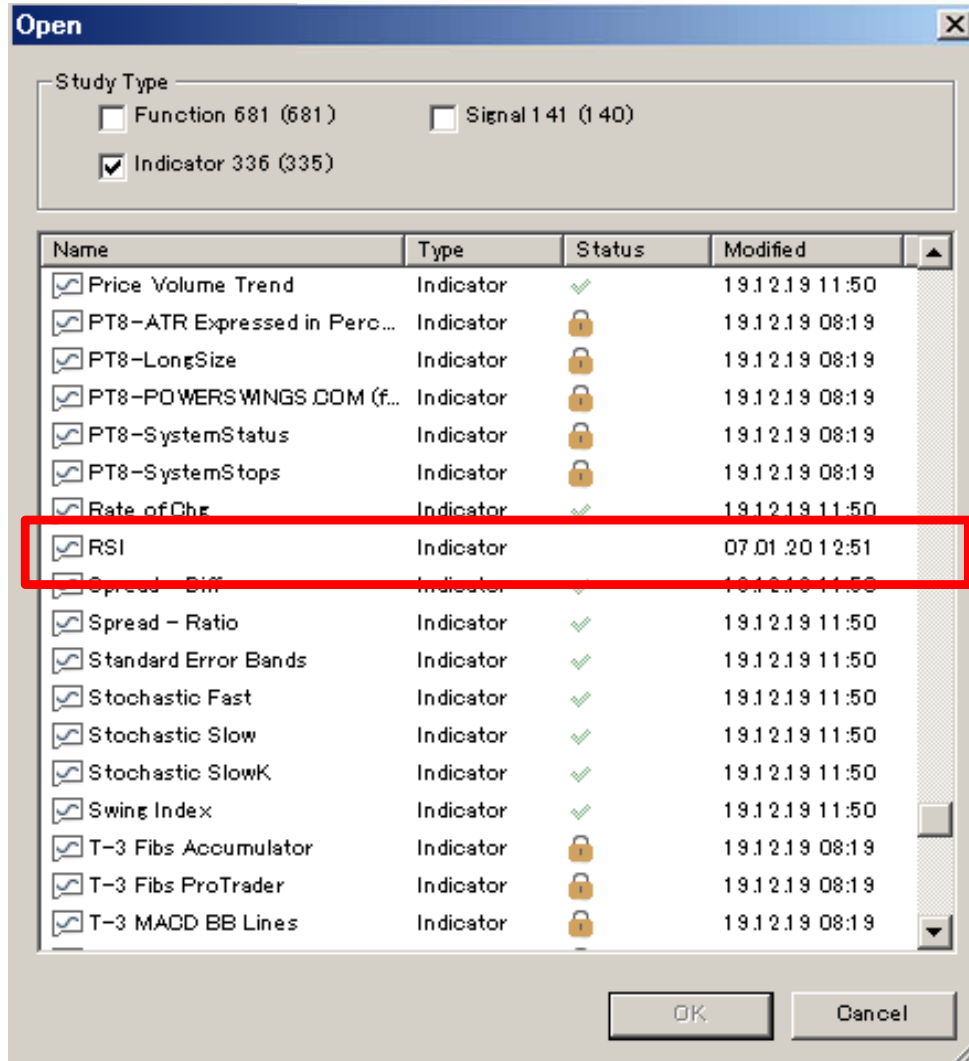
$$RSI = A \div (A + B) \times 100(\%)$$

A : n日間の値上がり幅の平均

B : n日間の値下がり幅の平均



マルチチャートでのRSI（インジケータ）



Price: Open, High, Low, Closeから選択
Length : RSIの計算期間
OverSold : 売られ過ぎの数値
OverBought : 買われ過ぎの数値

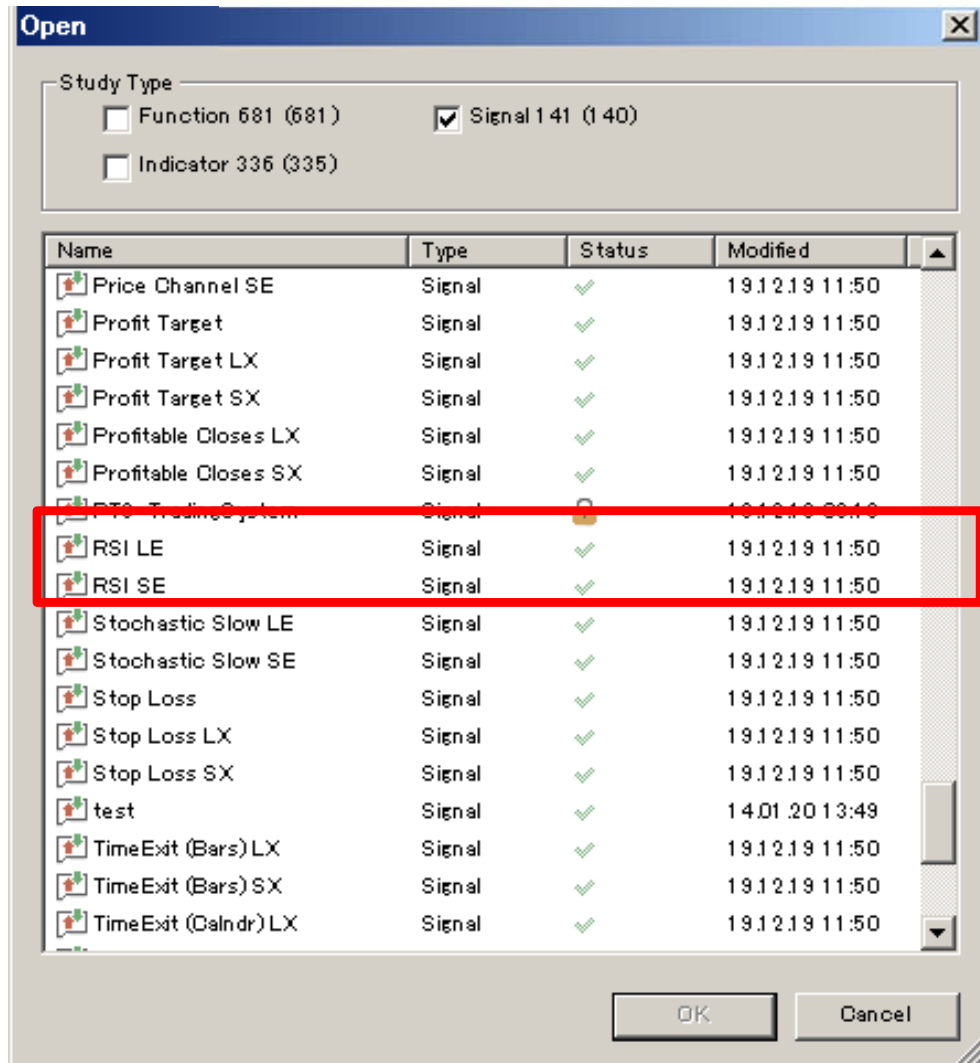


マルチチャートでのRSI（インジケーター）





マルチチャートでのRSI（ストラテジー）



・ RSI LE（ロング・エントリー）
CloseがOverSold(30)を上方クロスしたら(Cross Over)ロング

・ RSI SE（ショート・エントリー）
CloseがOverBought(70)を下方クロスしたら(Cross Under)ショート



逆張り



マルチチャートでのRSI（ストラテジー）

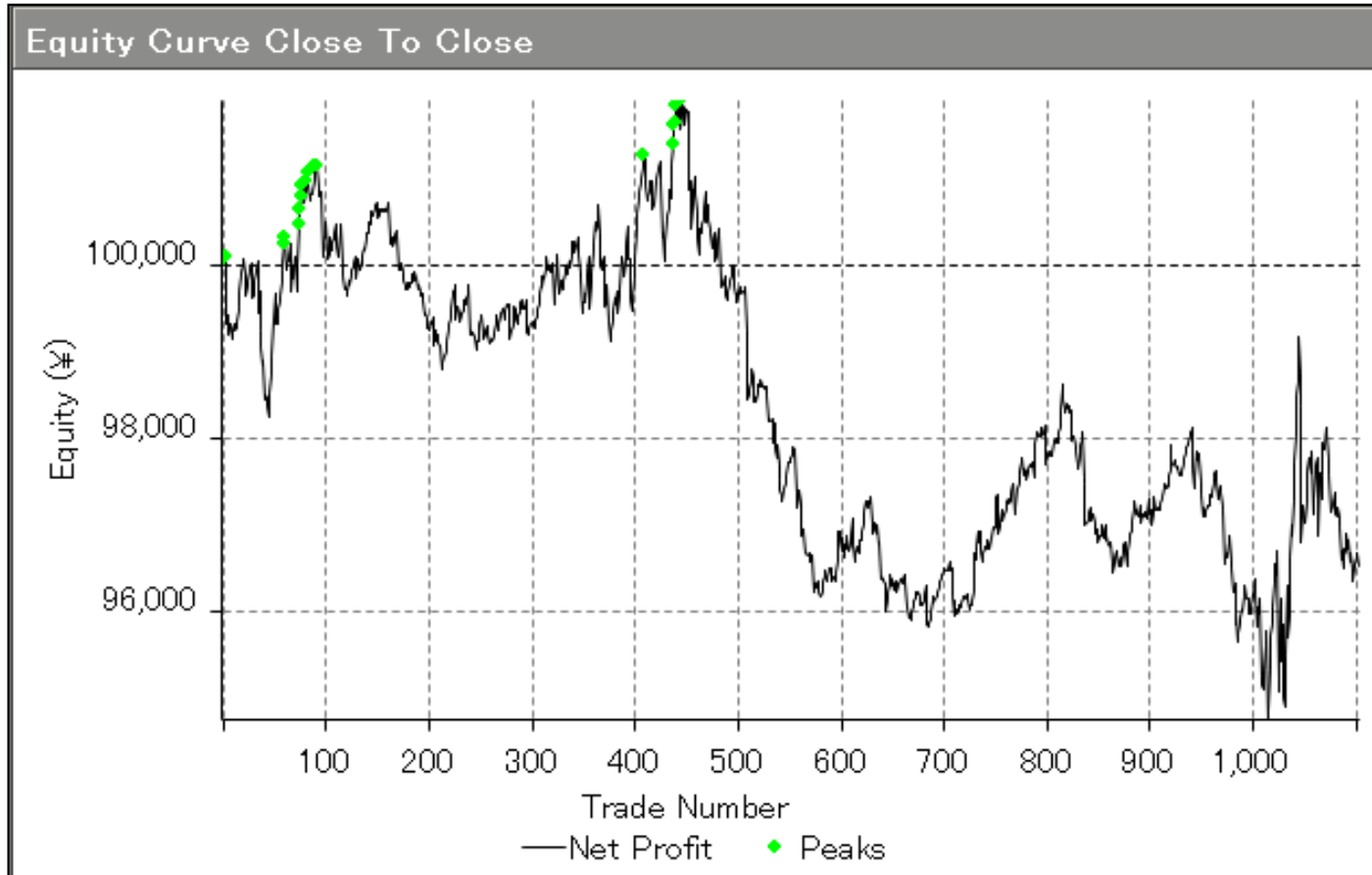
- ・ RSI LE（ロング・エントリー）
CloseがOverSold(30)を上方クロスしたら(Cross Over)ロング
- ・ RSI SE（ショート・エントリー）
CloseがOverBought(70)を下方クロスしたら(Cross Under)ショート





マルチチャートでのRSI（ストラテジー）

- ・ RSI LE（ロング・エントリー）
CloseがOverSold(30)を上方クロスしたら(Cross Over)ロング
- ・ RSI SE（ショート・エントリー）
CloseがOverBought(70)を下方クロスしたら(Cross Under)ショート





マルチチャートでのRSI（ストラテジー）順張り戦略例

『株価指数先物必勝システム』

著者 アート・コリンズ

第39章 よく知られた指標1-RSI

一般に日足では14日RSI、5分足では9本RSIを使う。

<5分足順張りルール>

●エントリー：

5分足9本のRSIが85%以上の時、次の始値でロング（15%以下になったらショート）。

※引けまでに30分を切れれば仕掛けない。

※サクソバンク証券CFDの225JPで検証

2018年1月～2020年5月7日まで。

※8時45分から14時45分までとした。

●エグジット：

大引け5分前に全てのポジションを手仕舞う。

※15時10分とした。





マルチチャートでのRSI（ストラテジー） 順張り戦略例

```
inputs:RSILength(9);
```

(LONG)

```
if time >= 845 and time <= 1445  
and RSI(close,RSILength) >= 85  
then buy next bar at market;
```

```
if time = 1510 and marketposition = 1  
then sell next bar at market;
```

(SHORT)

```
if time >= 845 and time <= 1445  
and RSI(close,RSILength) <= 15  
then sellshort next bar at market;
```

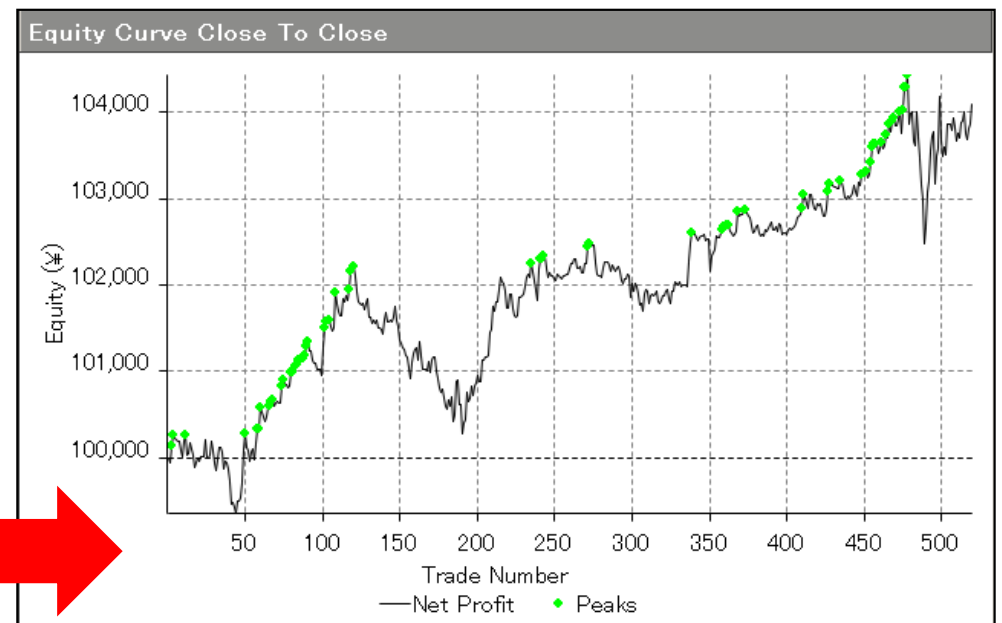
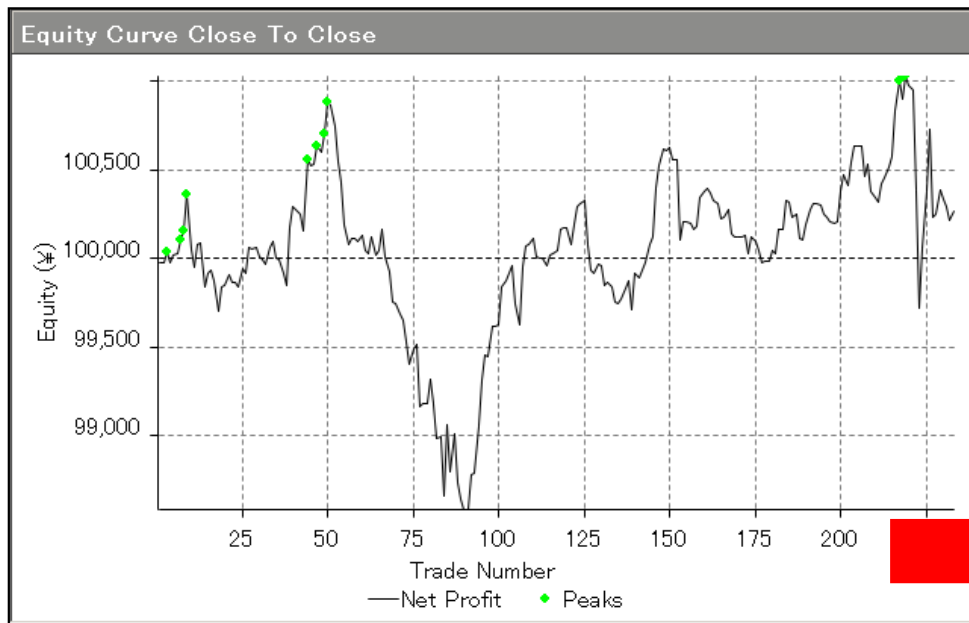
```
if time = 1510 and marketposition = -1  
then buytocover next bar at market;
```





マルチチャートでのRSI（ストラテジー）順張り戦略例

2018年1月1日から2020年5月7日まで



RSIのパラメータを5から14までで最適化してみると・・・最適値は「5」



MULTICHARTS

Raising The Trading Standard

パンローリングはマルチチャートの日本の正規代理店です。マルチチャートの試用版は下記のURLまたは右下のQRコードからお申込みください。

<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011174100005>

まずはお試してください！

マルチチャート日本語サイトはこちら

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/>





パンローリングチャンネル



第1回 10分トレードから学ぶエントリー&エグジット編

<https://youtu.be/KJ3gMlfMLpo>

第2回 10分トレードから学ぶ早期エグジット編

<https://youtu.be/rSVRIIs61vKc>

第3回 10分トレードから学ぶ利益確定&ロスカット編

<https://youtu.be/ykErg3MtvA4>

第4回 10分トレードから学ぶまとめ編

<https://youtu.be/OiAIQOeKIKY>